UEDA YAGI MONTHLY DATA ＜平成 27年（2015年） 11月＞

― 資金需給動向とONレートの足どり・主要諸指標 上田八木短資株式会社 ―

平成 27 年 12 月 1 日

利 率： %

金額単位：億円

*速報ベース

平成27年11月		無担ＯＮ* 加重平均	無担ＯＮ* 最低/最高	資金過不足 銀行券	資金過不足 財政等	資金過不足 過不足尻	オペエンド 貸出	オペエンド CP・国債 手形・共通担保資金供給オペ	オペエンド 計(△)	オペスタート 貸出	オペスタート 手形・共通担保資金供給オペ	オペスタート CP・国債 国庫短期証券・企業金融支援	オペスタート 計	日銀当預増減	日銀当預残高（日銀当預・準備預金（後半所要 65,400））	準備預金残高	積終了先	注2) TB 3ヵ月	ユーロ円 注3) 3ヵ月	ユーロ円 金利先物 3ヵ月	新発10年国債	東証平均株価	東証一部出来高	注6) 為替円相場
			0.030					国債補完供給 ＋ 300																120.27
								CP等買入 △ 500																
2	月	0.076	0.125	△ 100	△ 18,700	△ 18,800		共通担保(全店) △ 1,100	△ 1,300		共通担保(全店) ＋ 500	国債買入 ＋ 12,100	＋ 12,600	△ 7,500	＋ 2,464,300	＋ 2,237,900	＋ 1,840,300	▲ 0.001	0.16900	0.130	0.305	18,683.24	21.71	120.58
			0.060																					121.00
4	水	0.085	0.125	＋ 1,200	△ 15,800	△ 14,600		CP等買入 △ 100	△ 100			国債補完供給 △ 200	△ 200	△ 14,900	＋ 2,449,400	＋ 2,229,600	＋ 1,827,700	▲ 0.002	0.16900	0.140	0.310	18,926.91	26.94	121.38
			0.060					国債補完供給 ＋ 200																121.39
5	木	0.077	0.125	＋ 900	＋ 7,300	＋ 8,200		CP等買入 △ 600	△ 400			国庫短期証券買入 ＋ 7,500	＋ 7,500	＋ 15,300	＋ 2,464,700	＋ 2,242,600	＋ 1,841,000	▲ 0.005	0.16900	0.140	0.310	19,116.41	24.53	121.65
			0.060																					121.64
6	金	0.077	0.125	＋ 400	＋ 7,600	＋ 8,000		CP等買入 △ 300	△ 300			国債買入 ＋ 12,100	＋ 12,100	＋ 19,800	＋ 2,484,500	＋ 2,256,300	＋ 1,852,300	▲ 0.005	0.16900	0.140	0.315	19,265.60	20.36	121.93
			0.060					CP等買入 △ 200																123.18
9	月	0.078	0.125	＋ 1,200	△ 29,300	△ 28,100		共通担保(全店) △ 2,400	△ 2,600		共通担保(全店) ＋ 1,700		＋ 1,700	△ 29,000	＋ 2,455,500	＋ 2,236,300	＋ 1,833,900	▲ 0.005	0.16900	0.135	0.330	19,642.74	25.14	123.49
			0.060									ETF買入 ＋ 100												123.03
												CP等買入 ＋ 3,500												
10	火	0.077	0.130	＋ 1,000	△ 16,800	△ 15,800		CP等買入 △ 500	△ 500			国債買入 ＋ 4,800	＋ 8,400	△ 7,900	＋ 2,447,600	＋ 2,223,800	＋ 1,821,100	▲ 0.005	0.16900	0.135	0.310	19,671.26	20.69	123.39
			0.060									国庫短期証券買入 ＋ 17,500												122.74
11	水	0.078	0.125	＋ 400	＋ 300	＋ 700		CP等買入 △ 500	△ 500			国債買入 ＋ 12,200	＋ 29,700	＋ 29,900	＋ 2,477,500	＋ 2,254,300	＋ 1,850,000	▲ 0.005	0.16900	0.140	0.315	19,691.39	21.35	123.22
			0.060																					122.74
12	木	0.078	0.125	△ 300	△ 2,300	△ 2,600		CP等買入 △ 100	△ 100					△ 2,700	＋ 2,474,800	＋ 2,254,200	＋ 1,850,800	▲ 0.006	0.16900	0.145	0.305	19,697.77	20.97	123.04
			0.065									ETF買入 ＋ 200												122.50
13	金	0.078	0.125	△ 400	＋ 3,300	＋ 2,900		CP等買入 △ 900	△ 900			国債買入 ＋ 12,100	＋ 12,300	＋ 14,300	＋ 2,489,100	＋ 2,268,100	＋ 1,861,100	▲ 0.035	0.16900	0.145	0.300	19,596.91	22.22	122.78
			0.060					CP等買入 △ 300				ETF買入 ＋ 100												122.23
16	月	0.078	0.125	＋ 1,000	△ 21,200	△ 20,200		共通担保(全店) △ 1,200	△ 1,500		共通担保(全店) ＋ 1,100	社債等買入 ＋ 800	＋ 900	△ 19,700	＋ 2,469,400	＋ 2,248,100	＋ 668,600	▲ 0.035	0.16900	0.145	0.300	19,393.69	17.87	122.66
			0.060									国債補完供給 △ 100												123.18
												国庫短期証券買入 ＋ 15,000												
17	火	0.078	0.125	＋ 200	＋ 500	＋ 700		CP等買入 △ 100	△ 100			国債買入 ＋ 8,100	＋ 23,000	＋ 23,600	＋ 2,493,000	＋ 2,267,200	＋ 1,741,700	▲ 0.036	0.16900	0.145	0.295	19,630.63	22.50	123.43
			0.125					国債補完供給 ＋100																123.24
18	水	0.084	0.060	△ 800	△ 2,000	△ 2,800		CP等買入 △ 300	△ 200			国債買入 ＋ 900	＋ 900	△ 2,100	＋ 2,490,900	＋ 2,266,600	＋ 1,806,400	▲ 0.068	0.16900	0.145	0.295	19,649.18	19.37	123.48
			0.060									ETF買入 ＋ 300												123.09
19	木	0.078	0.125	△ 1,900	△ 29,900	△ 31,800		CP等買入 △ 200	△ 200			CP等買入 ＋ 3,500	＋3,800	△ 28,200	＋ 2,462,700	＋ 2,235,800	＋ 1,809,600	▲ 0.112	0.16900	0.140	0.295	19,859.81	20.77	123.64
			0.065					社債等買入 △ 100				ETF買入 ＋ 100												122.75
20	金	0.077	0.080	△ 2,100	△ 14,200	△ 16,300		CP等買入 △ 600	△ 700			国債買入 ＋ 12,100	＋12,200	△ 4,800	＋ 2,457,900	＋ 2,239,700	＋ 1,826,900	▲ 0.104	0.16900	0.140	0.310	19,879.81	18.44	123.06
			0.060					共通担保(全店) △ 2,700																122.64
24	火	0.078	0.125	△ 600	△ 5,400	△ 6,000		CP等買入 △ 400	△ 3,100		共通担保(全店) ＋ 2,800	ETF買入 ＋ 100	＋2,900	△ 6,200	＋ 2,451,700	＋ 2,234,200	＋ 1,819,400	▲ 0.104	0.16900	0.150	0.315	19,924.89	20.62	122.95
			0.060					社債等買入 △ 100				ETF買入 ＋ 200												122.27
25	水	0.078	0.125	△ 800	△ 3,200	△ 4,000		CP等買入 △ 1,000	△ 1,100			国庫短期証券買入 ＋ 2,500	＋ 2,700	△ 2,400	＋ 2,449,300	＋ 2,231,600	＋ 1,816,400	▲ 0.103	0.16900	0.150	0.300	19,847.58	20.07	122.56
			0.060									ETF買入 ＋ 100												122.55
26	木	0.076	0.125	△ 2,600	＋ 700	△ 1,900		CP等買入 △ 300	△ 300			国債買入 ＋ 11,100	＋ 11,200	＋ 9,000	＋ 2,458,300	＋ 2,241,800	＋ 1,827,900	▲ 0.085	0.16900	0.145	0.295	19,944.41	18.68	122.80
			0.060																					122.32
27	金	0.077	0.125	△ 2,000	△ 15,900	△ 17,900		CP等買入 △ 700	△ 700			ETF買入 ＋ 200	＋ 200	△ 18,400	＋ 2,439,900	＋ 2,222,300	＋ 1,813,900	▲ 0.050	0.16900	0.145	0.300	19,883.94	18.51	122.73
			0.060					CP等買入 △ 3,500				国債補完供給 △ 200												122.69
												CP等買入 ＋ 4,500												
30	月	0.076	0.080	△ 100	＋ 10,100	＋ 10,000		共通担保(全店) △ 1,600	△ 5,100		共通担保(全店) ＋ 1,300	国債買入 ＋ 8,200	＋ 13,800	＋ 18,700	＋ 2,458,600	＋ 2,249,100	＋ 1,843,200	▲ 0.050	0.16900	0.145	0.300	19,747.47	24.66	122.86
月中平均		0.0781	―	月中実績 △ 5,589	月中実績 △ 144,620	月中実績 △ 150,209	―	国債買入 ＋ 93,500	―	月中実績 ＋ 0	月中実績 △ 1,507	月中実績 ＋ 2,452	月中実績 ＋ 945	―	前月末比 △ 13,232	―	―	▲ 0.043	0.16900	0.142	0.306	19,581.77	21.34	122.55
月中* 平均		0.0777	―	月末残高 931,591	―	―	―	国庫短期証券買入 ＋ 42,532	―	月末残高 ＋ 0	月末残高 ＋ 64,615	月末残高 ＋ 475,042	月末残高 ＋ 539,657	―	―	―	―	―	―	―	―	―	―	―

*暦日ベース

基準貸付金利 0.75 %(H19. 2.21～) / 0.50 %(H20. 10.31～) / 0.30 %(H20. 12.19～)

短期プライム 1.475 %(H21.1.13～)

長期プライム 1.15 %(H27.2.10～) / 1.10 %(H27.9.10～)

注1) 日本銀行発表

注2) TB567～TB573回儲(日本相互証券)日本経済新聞

注3) TIBOR(東京銀行間取引金利) 日本経済新聞

注4) 中心限月 金利換算値 公式終値 日本経済新聞

注5) 340回儲(日本相互証券)日本経済新聞

注6) 上段は高値、下段は安値 日本経済新聞